

# 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资 基金 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：渤海汇金证券资产管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经董事会审议，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期为 2018 年 7 月 20 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 7         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 8         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 8         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | <b>9</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 9         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 9         |
| 3.3 其他指标.....                                | 11        |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 11        |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>12</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 12        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 13        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 14        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 16        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 16        |
| 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....        | 16        |
| 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....      | 16        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>17</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 17        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 17        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 17        |
| <b>§6 审计报告</b> .....                         | <b>18</b> |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 18        |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 18        |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | <b>21</b> |
| 7.1 资产负债表.....                               | 21        |
| 7.2 利润表.....                                 | 22        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 23        |
| 7.4 报表附注.....                                | 24        |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                       | <b>51</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 51        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 51        |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 52        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 56        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 58        |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....    | 58        |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 58        |
| 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... | 59        |
| 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....    | 59        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 59        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 59        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 60        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>62</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 62        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 62        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....     | 62        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>63</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>64</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 64        |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....      | 64        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 64        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 64        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 64        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 64        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 64        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 65        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>             | <b>70</b> |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....   | 70        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 70        |
| <b>§13 备查文件目录 .....</b>                     | <b>71</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 71        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 71        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 71        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                       |
|--------------|-----------------------|
| 基金名称         | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称         | 渤海汇金量化汇盈混合            |
| 场内简称         | -                     |
| 基金主代码        | 005021                |
| 前端交易代码       | -                     |
| 后端交易代码       | -                     |
| 基金运作方式       | 契约型开放式                |
| 基金合同生效日      | 2018年7月20日            |
| 基金管理人        | 渤海汇金证券资产管理有限公司        |
| 基金托管人        | 中国工商银行股份有限公司          |
| 报告期末基金份额总额   | 60,511,453.66份        |
| 基金合同存续期      | -                     |
| 基金份额上市的证券交易所 | -                     |
| 上市日期         | -                     |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 通过构建数量化投资策略，在严格控制风险的基础上，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，实现基金资产的持续稳健增长。   |
| 投资策略 | <p>本基金运用现代金融学、数学、统计学等科学方法，借助计算机的信息处理能力，在大类资产配置、行业配置和个股配置三个层面构建数量化投资策略，捕捉各种市场特征下的投资机会，同时辅以量化模型控制基金整体的波动和风险，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。</p> <p>1、大类资产配置策略：<br/>采用风险平价模型等量化分析的方法构建大类资产配置模型，动态配置股票与债券资产的投资比例，平衡分配不同资产类别的风险贡献度，避免投资组合暴露在单一资产类别的风险敞口中，从而动态控制基金资产的整体风险。同时结合国内外宏观经济走势、财政货币政策、行业发展趋势等因素，辅以定性分析来增强大类资产配置的功效。</p> <p>2、行业配置策略：<br/>通过跟踪各行业的景气度、盈利能力、分析师的盈利预期、行业估值等基本面因子，结合行业指数的波动指标、动量变化指标等市场因子，构建行业轮动模型，捕捉最具有投资价值的行业，并动态调整权益资产中</p> |

行业配置，提升具有投资价值行业的比例，降低投资价值较低的行业比例，实现相对较优的行业配置，获取行业配置的超额阿尔法收益。

### 3、量化股票投资策略：

(1) 多因子选股策略：通过对股票历史数据的数量化分析，充分挖掘影响股票价格的因子，通过检验各类因子的有效性以及因子之间的关联度，对各类因子打分挑选出有效的因子组合，并结合风险和收益特征构建多因子模型，筛选出收益预期较高且风险可控的股票组合。本基金使用的因子不仅包括公司盈利能力、成长性、一致预期、估值等基本面类因子，同时也包括股票价格波动相关的各类技术指标，例如价格波动率、成交量、动量趋势、超买超卖等。本基金通过对量化模型中各类因子的持续跟踪来监控因子的有效性，根据市场状况结合因子变化趋势，动态选取最优因子构建股票多头组合，并根据市场变化趋势，对模型进行调整，以改进模型的有效性。

(2) 统计套利选股策略：基于均值回归的思想，通过分析历史数据统计投资标的之间存在的稳定性关系。当标的之间的价格波动导致既定关系出现偏离时，这种趋势大概率在未来会得到修正，便会出现套利机会。借助计算机自动捕捉套利机会，挑选历史上大概率跑赢市场的股票组合，以相对较高的成功概率进场套利。

(3) 事件套利选股策略：通过跟踪分析对投资者行为产生一定影响，可造成市场短期价格波动的事件来获取超额投资收益。此类事件包括但不限于定向增发、股东增持、股权激励、业绩公告、资产注入等，相关事件信息要素均由上市公司公告等公开渠道获得。

### 4、债券投资策略：

本基金在保障流动性的基础上，有效利用基金资产进行债券投资，以提高基金资产的投资收益。

首先，通过对国内外宏观经济形势、财政政策、货币政策以及债券市场供求关系等因素的分析，结合基金资产的流动性需求，确定债券组合的规模、投资期限、期间的流动性安排。

其次，在上述约束条件下，综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。

此外，本基金根据对可转换债券的发行条款和对应基础证券的估值与价格变化的研究，通过对转债品种的转股溢价率、纯债溢价率、到期收益率等指标分析，寻找具有债性支撑并且兼具一定股性的品种，捕捉其投资机会。

### 5、股指期货和国债期货投资策略：

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，选择流动性较强、交易活跃的期货合约进行空头或多头套期保值，以管理投资组合的系统性风险，提高资金使用效率。</p> <p>基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。此外，基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组，并授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项。</p> <p>基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p>6、资产支持证券投资策略：</p> <p>本基金将通过宏观经济等多个因素的研究预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时在严格控制风险的情况下，综合运用多个策略和研究方法，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>7、权证投资策略</p> <p>本基金将在严格控制风险、保障基金财产安全的前提下对权证进行投资。本基金将对权证标的证券基本面研究，采取市场公认的权证定价模型作为权证投资的价值基准，同时充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征进行谨慎投资。此外根据权证衍生工具的特征，通过权证与标的证券组合投资，以期改善组合的风险收益。</p> |
| 业绩比较基准 | 60%×沪深 300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人          | 基金托管人        |
|---------|------|----------------|--------------|
| 名称      |      | 渤海汇金证券资产管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 周磊             | 郭明           |
|         | 联系电话 | 010-68784298   | 010-66105799 |

|        |      |   |                     |
|--------|------|---|---------------------|
|        | 电子邮箱 | shenkeji@msn.com                        | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 |      | 400-651-5988/<br>400-651-1717           | 95588               |
| 传真     |      | 022-23861651                            | 010-66105798        |
| 注册地址   |      | 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司) | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 办公地址   |      | 深圳市南山区海德三道19号海岸大厦西座2901室                | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 邮政编码   |      | 518052                                  | 100140              |
| 法定代表人  |      | 徐海军                                     | 易会满                 |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报  |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="https://www.bhhjamc.com">https://www.bhhjamc.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人住所   |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                   |
|--------|----------------------|------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼 |
| 注册登记机构 | 渤海汇金证券资产管理有限公司       | 天津市南开区宾水西道8号           |



## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2018年7月20日<br>(基金合同生效日)-2018年12月<br>31日 | 2017年  | 2016年  |
|---------------|---|--------|--------|
| 本期已实现收益       | 663,685.85                              | -      | -      |
| 本期利润          | -189,035.87                             | -      | -      |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0019                                 | -      | -      |
| 本期加权平均净值利润率   | -0.18%                                  | -      | -      |
| 本期基金份额净值增长率   | -0.90%                                  | -      | -      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018年末                                  | 2017年末 | 2016年末 |
| 期末可供分配利润      | -543,663.19                             | -      | -      |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0090                                 | -      | -      |
| 期末基金资产净值      | 59,967,790.47                           | -      | -      |
| 期末基金份额净值      | 0.9910                                  | -      | -      |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2018年末                                  | 2017年末 | 2016年末 |
| 基金份额累计净值增长率   | -0.90%                                  | -      | -      |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金合同于2018年7月20日生效，截至本报告期末成立未满1年，本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.2 基金净值表现

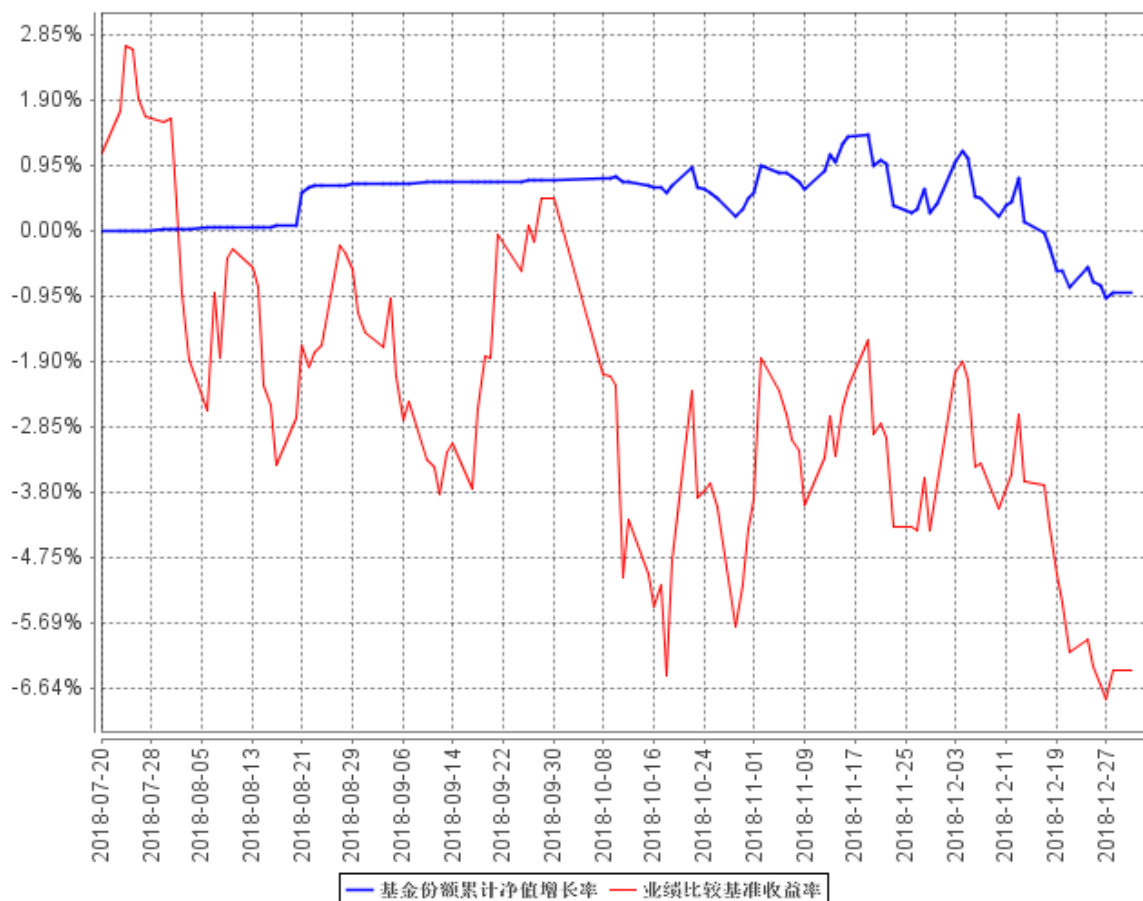
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月          | -1.63%       | 0.23%               | -6.83%             | 0.98%                 | 5.20% | -0.75% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -0.90%       | 0.18%               | -6.38%             | 0.90%                 | 5.48% | -0.72% |

注：业绩比较基准：上证国债指数收益率×40%+沪深 300 指数收益率×60%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

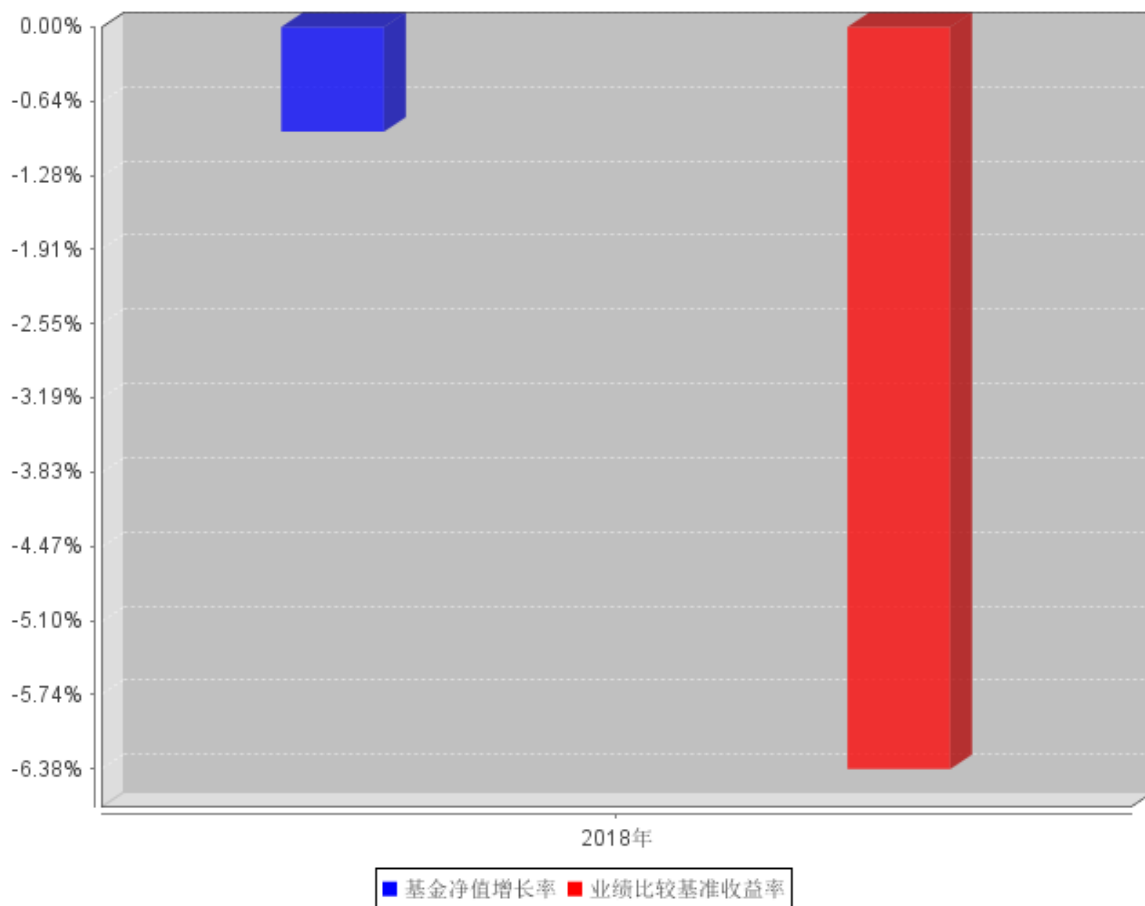


注：1、本基金合同生效日为 2018 年 7 月 20 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年；

2、自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末，本基金尚处于建仓期。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2018 年 7 月 20 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

渤海汇金证券资产管理有限公司（简称渤海汇金、渤海汇金资管）前身为渤海证券资产管理总部，经中国证监会证监许可[2016]3号文批准，成立于2016年5月18日。注册地为深圳，注册资本为11亿元，业务范围为证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务，是渤海证券股份有限公司的全资子公司。

截至2018年12月31日，本基金管理人共管理5只基金：渤海汇金汇添金货币市场基金、渤海汇金汇增利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金汇添益3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金、渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务                       | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|--------------------------|-----------------|------|--------|--|
|    |                          | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 何翔 | 本基金的基金经理、公募投资总监、公募投资部总经理 | 2018年7月20日      | -    | 14年    | 南开大学数学学士、金融学硕士。2004年2月至2013年10月就职于渤海证券研究所，任金融工程部经理。2013年10月至2016年8月就职于渤海证券基金管理总部，任投资研究部经理。2016年8月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，任公募投资总监。2017年7月至2018年12月10日担任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2018年2月起担任渤海汇金睿选混合基金基金经理。2018年7月起担任渤海汇金量化汇盈混合基金基金经理。 |

|    |              |                    |   |     |   |
|----|--------------|--------------------|---|-----|---|
| 林思 | 本基金的<br>基金经理 | 2018 年 7 月<br>20 日 | - | 7 年 | 南开大学金融工程硕士。2011 年 7 月至 2013 年 10 月就职于渤海证券研究所，任金融工程分析师。2013 年 10 月至 2016 年 8 月就职于渤海证券基金管理总部，任基金经理助理。2016 年 8 月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，任基金经理。2017 年 7 月至 2018 年 12 月 10 日担任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2018 年 7 月起担任渤海汇金量化汇盈混合基金基金经理。 |
|----|--------------|--------------------|---|-----|---|

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

按照中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司《渤海汇金证券资产管理有限公司公募业务公平交易制度》，以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现，结合盘中实时监控，事后分析和信息披露等风险控制措施加强对于公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合在获得投资信息、投资建议和实时投资决策方面享有公平的机会。交易员按最优原则，对投资指令进行综合平衡，保证交易在各资产组合间的公平执行，保证各类投资人得到公平对待。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，报告期内，本基金未发生异常交易行为，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交的单边交易量超过该证券交易当日成交量的 5% 的情形。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年股票市场出现了单边调整，上证综指、沪深 300、中小板指、创业板指分别下跌 21.4%、21.6%、34.1%、25.9%。分行业看，传媒、有色金属、电子跌幅较大，而银行、休闲服务、采掘跌幅较小。2018 年实体经济去杠杆和金融体系去杠杆是主导全年最主要的宏观政策环境，叠加中美贸易纠纷的影响，也使得股票市场出现了持续的调整。

报告期内，本基金以严格风险控制为前提，通过对宏观环境的研判和量化策略分析，稳健配置大类资产，控制基金净值波动与回撤，在股票市场大部分时间维持震荡下跌的环境下，较好的保持了基金净值的稳定。2018 年下半年股票市场经过长期的风险释放后，我们的量化估值体系显示股票资产已经逐步具备相对估值优势和长期配置价值，基金在稳健运作的前提下通过量化选股策略逐步提高股票资产的配置比例以增强基金资产未来的持续收益能力。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9910 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.90%，业绩比较基准收益率为-6.38%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，从基本面看，经济增长继续承压。目前投资仍是拉动经济的主要动力。2019 年投资将呈现“两上一下”的格局，基建投资托底的必要性上升；制造业投资继续温和增长；受

到棚改监管的限制，房地产投资将会下滑。出口受到中美贸易冲突长期化和全球经济下滑压力，将会出现明显下滑，对中国经济增长的贡献继续减小。消费在目前居民部门高杠杆及收入水平有所下滑的情况下也很难起到拉动经济增长的作用。从政策面看，将会采取更为积极的财政政策，货币政策将由稳健中性转为稳健宽松，维持流动性“合理充裕”。美联储加息路径的放缓也为我国货币政策的独立性留出更大空间，在基本面企稳前，难言转向。从市场情绪看，2019 年宽信用的政策还会逐步发力，效果将会逐渐显现，市场风险偏好将有所修复。

预计 2019 年股票市场会在风险偏好修复的波动下震荡筑底，股票资产长期配置价值愈加凸显，市场结构性机会亦会逐步涌现，科技成长类等新经济相关板块会迎来更多投资机会。2019 年债券市场在低利率的环境下也仍然存在一定的配置和交易机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性管理。明确合规标准且风险可控的前提下，积极响应业务需求，为业务发展提供合规支持。既保证业务顺利展开，又防范了重大合规风险。在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。对于新产品、新业务，在投资范围、投资工具、运作规则等方面，重点关注防控风险。同时，加强反洗钱、反恐怖融资和反逃税工作。

为进一步规范公司合规管理工作，将合规管理渗透到公司各部门，建立公司依法经营、合规运作的长效机制，公司修订了《渤海汇金证券资产管理有限公司法律合规部管理办法》、《渤海汇金证券资产管理有限公司合规检查管理规定》、《渤海汇金证券资产管理有限公司合规管理人员职责管理细则》等制度。建立各项业务间风险、合规信息的沟通与共享机制，充分发挥风控合规工作统筹协调的作用，实现在关键业务开展、新规则实施前及突发业务发生时，合规风控明确标准，相关业务部门共同参与讨论，建立更新流程，做到关键业务的风险可控。

同时，完成日常法律事务工作，包括合同、协议审查（包括各类产品及业务），主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，消除新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险隐患。

此外，我们还积极配合监管机关进行各类统计调查工作，按时完成季度、年度监察稽核报告及附表。

公司监察稽核工作整体平稳开展，根据监管变化和基金业务开展情况，适时调整工作安排，提高监察稽核工作质量，明确监察稽核各业务环节工作职责，规范稽核工作程序，加强对公司各业务条线、各部门的管理和监督，防范和控制风险，改善公司的经营管理情况。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由投资负责人、研究负责人、产品设计负责人、财务负责人、运营保障负责人、风险控制部和法律合规部负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。公募投资部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同（第十六部分基金的收益与分配中三、基金收益分配原则）的约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金的管理人渤海汇金证券资产管理有限公司在渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对渤海汇金证券资产管理有限公司编制和披露的渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2019)第 26123 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

|                 |   |
|-----------------|---|
| 审计报告标题          | 审计报告  |
| 审计报告收件人         | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人  |
| 审计意见            | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“渤海汇金量化汇盈混合基金”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 年 7 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了渤海汇金量化汇盈混合基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 7 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于渤海汇金量化汇盈混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>  |
| 强调事项            | -   |
| 其他事项            | -   |
| 其他信息            | -   |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 渤海汇金量化汇盈混合基金的基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准   |

|                 |  |
|-----------------|--|
|                 | <p>则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估渤海汇金量化汇盈混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算渤海汇金量化汇盈混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督渤海汇金量化汇盈混合基金的财务报告过程。</p>  |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的</p> |

|           |   |    |
|-----------|---|----|
|           | <p>并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对导致对渤海汇金量化汇盈混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致渤海汇金量化汇盈混合基金不能持续经营。</p> <p>(五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |    |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  |    |
| 注册会计师的姓名  | 李铁英   | 朱辉 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼   |    |
| 审计报告日期    | 2019 年 3 月 22 日   |    |

注：会计师出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 239,748.62                      | -                                |
| 结算备付金           |            | 1,568,760.18                    | -                                |
| 存出保证金           |            | 777,671.00                      | -                                |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 39,653,442.30                   | -                                |
| 其中：股票投资         |            | 8,715,491.00                    | -                                |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 30,937,951.30                   | -                                |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | 17,400,000.00                   | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 6,499.48                        | -                                |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 617,965.26                      | -                                |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | -                               | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 60,264,086.84                   | -                                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                 |                                  |
| 短期借款            |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款           |            | 53,651.70                       | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 77,715.19                       | -                                |
| 应付托管费           |            | 12,952.53                       | -                                |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 16,842.16                       | -                                |
| 应交税费            |            | -                               | -                                |

|               |          |               |   |
|---------------|----------|---------------|---|
| 应付利息          |          | -             | - |
| 应付利润          |          | -             | - |
| 递延所得税负债       |          | -             | - |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 135,134.79    | - |
| 负债合计          |          | 296,296.37    | - |
| <b>所有者权益：</b> |          |               |   |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 60,511,453.66 | - |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | -543,663.19   | - |
| 所有者权益合计       |          | 59,967,790.47 | - |
| 负债和所有者权益总计    |          | 60,264,086.84 | - |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9910 元，基金份额总额 60511453.66 份。

## 7.2 利润表

会计主体：渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 7 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2018 年 7 月 20 日(基<br>金合同生效日)至<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|---|--|
| <b>一、收入</b>            |            | 774,106.83  | -  |
| 1. 利息收入                |            | 1,342,661.21  | -  |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 283,145.26  | -  |
| 债券利息收入                 |            | 580,474.04  | -  |
| 资产支持证券利息收入             |            | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入             |            | 479,041.91  | -  |
| 其他利息收入                 |            | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -356,824.42   | -  |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | -142,335.39   | -  |
| 基金投资收益                 |            | -   | -  |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13   | -134,850.00   | -  |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.13.5 | -   | -  |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.14   | -   | -  |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.15   | -81,879.03  | -  |
| 股利收益                   | 7.4.7.16   | 2,240.00  | -  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | -852,721.72   | -  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -   | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.18   | 640,991.76  | -  |
| <b>减：二、费用</b>          |            | 963,142.70  | -  |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 679,436.55  | -  |

|                            |            |             |   |
|----------------------------|------------|-------------|---|
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 113,239.43  | - |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | -           | - |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19   | 26,234.05   | - |
| 5. 利息支出                    |            | -           | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -           | - |
| 6. 税金及附加                   |            | 163.08      | - |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.20   | 144,069.59  | - |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -189,035.87 | - |
| 减：所得税费用                    |            | -           | - |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -189,035.87 | - |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 7 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2018 年 7 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |             |                 |
|--|--|-------------|-----------------|
|  | 实收基金   | 未分配利润       | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 234,129,606.83                                   | -           | 234,129,606.83  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | -189,035.87 | -189,035.87     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -173,618,153.17                                  | -354,627.32 | -173,972,780.49 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 152,321.45                                       | 1,010.11    | 153,331.56      |
| 2. 基金赎回款                               | -173,770,474.62                                  | -355,637.43 | -174,126,112.05 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -           | -               |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 60,511,453.66                                    | -543,663.19 | 59,967,790.47   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日      |             |                 |

|  | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
|--|------|-------|---------|
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | -    | -     | -       |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -    | -     | -       |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -    | -     | -       |
| 其中：1. 基金申购款                            | -    | -     | -       |
| 2. 基金赎回款                               | -    | -     | -       |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -    | -     | -       |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | -    | -     | -       |

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 徐海军      | 周里勇       | 徐长莹     |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]第 371 号《关于准予渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》核准,由渤海汇金证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 234,005,295.59 元,经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2018)第 0493 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金合同》于 2018 年 7 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 234,129,606.83 份基金份额,其中认购资金利息折合 124,311.24 份基金份额。本基金的基金管理人为渤海汇金证券资产管理有



限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具(含同业存单)、资产支持证券、债券回购、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准： $60\% \times$  沪深 300 指数收益率 $+40\% \times$  上证国债指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司于 2019 年 3 月 22 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 7 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 7 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

-

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 7 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括应付管理人报酬和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为

应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

##### (1) 证券交易所上市的有价证券的估值

(a) 存在活跃市场的金融工具，以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值；且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价(收盘价)估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(b) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净

价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(c)交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(d)交易所上市的资产支持证券等不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(a)送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价(收盘价)估值；

(b)首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(c)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3)全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。

(4)同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(5) 本基金投资期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(6) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

(7) 本基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生

收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税，对存款利息收入不征收增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

(2) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(3) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴



20%的个人所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2018年12月31日 | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 239,748.62         | -                   |
| 定期存款         | -                  | -                   |
| 其中：存款期限1-3个月 | -                  | -                   |
| 其他存款         | -                  | -                   |
| 合计：          | 239,748.62         | -                   |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2018年12月31日  |               |               |           |
|---------------|---------------------|---------------|---------------|-----------|
|               | 成本                  | 公允价值          | 公允价值变动        |           |
| 股票            | 9,399,510.82        | 8,715,491.00  | -684,019.82   |           |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                   | -             | -             |           |
| 债券            | 交易所市场               | 11,349,663.20 | 11,426,951.30 | 77,288.10 |
|               | 银行间市场               | 19,508,510.00 | 19,511,000.00 | 2,490.00  |
|               | 合计                  | 30,858,173.20 | 30,937,951.30 | 79,778.10 |
| 资产支持证券        | -                   | -             | -             |           |
| 基金            | -                   | -             | -             |           |
| 其他            | -                   | -             | -             |           |
| 合计            | 40,257,684.02       | 39,653,442.30 | -604,241.72   |           |
| 项目            | 上年度末<br>2017年12月31日 |               |               |           |
|               | 成本                  | 公允价值          | 公允价值变动        |           |
| 股票            | -                   | -             | -             |           |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                   | -             | -             |           |
| 债券            | 交易所市场               | -             | -             |           |
|               | 银行间市场               | -             | -             |           |
|               | 合计                  | -             | -             |           |
| 资产支持证券        | -                   | -             | -             |           |
| 基金            | -                   | -             | -             |           |

|    |   |   |   |
|----|---|---|---|
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | - | - | - |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日  |      |    |    |
|--------|--------------------------|------|----|----|
|        | 合同/名义金<br>额              | 公允价值 |    | 备注 |
|        |                          | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具 | -                        | -    | -  |    |
| 货币衍生工具 | -                        | -    | -  |    |
| 权益衍生工具 | 5,338,640.00             | -    | -  |    |
| 股指期货投资 | 5,338,640.00             | -    | -  |    |
| 其他衍生工具 | -                        | -    | -  |    |
| 合计     | 5,338,640.00             | -    | -  |    |
| 项目     | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |      |    |    |
|        | 合同/名义金<br>额              | 公允价值 |    | 备注 |
|        |                          | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具 | -                        | -    | -  |    |
| 货币衍生工具 | -                        | -    | -  |    |
| 权益衍生工具 | -                        | -    | -  |    |
| 其他衍生工具 | -                        | -    | -  |    |
| 合计     | -                        | -    | -  |    |

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日  |           |
|-------|--------------------------|-----------|
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 17,400,000.00            | -         |
| 银行间市场 | -                        | -         |
| 合计    | 17,400,000.00            | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2018年12月31日 | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 37.22              | -                   |
| 应收定期存款利息   | -                  | -                   |
| 应收其他存款利息   | -                  | -                   |
| 应收结算备付金利息  | 135.41             | -                   |
| 应收债券利息     | 606,257.60         | -                   |
| 应收资产支持证券利息 | -                  | -                   |
| 应收买入返售证券利息 | 11,533.82          | -                   |
| 应收申购款利息    | -                  | -                   |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                  | -                   |
| 其他         | 1.21               | -                   |
| 合计         | 617,965.26         | -                   |

**7.4.7.6 其他资产**

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年12月31日 | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 15,792.16          | -                   |
| 银行间市场应付交易费用 | 1,050.00           | -                   |
| 合计          | 16,842.16          | -                   |

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年12月31日 | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | 134.79             | -                   |
| 预提费用        | 135,000.00         | -                   |
| 合计          | 135,134.79         | -                   |

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2018年7月20日(基金合同生效日)至2018年12月31日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额(份)                               | 账面金额            |
| 基金合同生效日       | 234,129,606.83                        | 234,129,606.83  |
| 本期申购          | 152,321.45                            | 152,321.45      |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -173,770,474.62                       | -173,770,474.62 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                                     | -               |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                     | -               |
| 本期申购          | -                                     | -               |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                                     | -               |
| 本期末           | 60,511,453.66                         | 60,511,453.66   |

注：(1)申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

(2)本基金于2018年5月22日至2018年7月17日止向社会公开募集，截至2018年7月20日(基金合同生效日)止，募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币234,005,295.59元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币124,311.24元，以上实收基金合计234,129,606.83元折合为234,129,606.83份渤海汇金量化汇盈混合份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分       | 未实现部分       | 未分配利润合计     |
|----------------|-------------|-------------|-------------|
| 基金合同生效日        | -           | -           | -           |
| 本期利润           | 663,685.85  | -852,721.72 | -189,035.87 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -369,928.81 | 15,301.49   | -354,627.32 |
| 其中：基金申购款       | 1,019.56    | -9.45       | 1,010.11    |
| 基金赎回款          | -370,948.37 | 15,310.94   | -355,637.43 |
| 本期已分配利润        | -           | -           | -           |
| 本期末            | 293,757.04  | -837,420.23 | -543,663.19 |

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2018年7月20日(基金合同生效日)至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|----|---------------------------------------|----------------------------------|
|    | 活期存款利息收入                              | 36,959.48                        |

|           |            |   |
|-----------|------------|---|
| 定期存款利息收入  | 242,666.67 | - |
| 其他存款利息收入  | -          | - |
| 结算备付金利息收入 | 3,513.34   | - |
| 其他        | 5.77       | - |
| 合计        | 283,145.26 | - |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2018年7月20日(基金<br>合同生效日)至2018年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017<br>年12月31日 |
|------------|---|--------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 2,822,881.86                                  | -                                    |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,965,217.25                                  | -                                    |
| 买卖股票差价收入   | -142,335.39                                   | -                                    |

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2018年7月20日(基金<br>合同生效日)至2018年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年<br>12月31日 |
|-----------------------------------|---|--------------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债<br>转股及债券到期兑付）差价收入 | -134,850.00                                   | -                                    |
| 债券投资收益——赎回差价收入                    | -   | -                                    |
| 债券投资收益——申购差价收入                    | -   | -                                    |
| 合计                                | -134,850.00                                   | -                                    |

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2018年7月20日(基金<br>合同生效日)至2018年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年<br>12月31日 |
|----|---|--------------------------------------|
|    |   |                                      |

|                         |                |   |
|-------------------------|----------------|---|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 280,000,000.00 | - |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 273,901,060.00 | - |
| 减：应收利息总额                | 6,233,790.00   | - |
| 买卖债券差价收入                | -134,850.00    | - |

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期收益金额 | 上年度可比期间收益金额 |
|----|--------|-------------|
|----|--------|-------------|

|           | 2018年7月20日(基金合同生效日)至2018年12月31日 | 2017年1月1日至2017年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|-----------------------|
| 股指期货-投资收益 | -81,879.03                      |                       |

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2018年7月20日(基金合同生效日)至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|-------------|---------------------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 2,240.00                              | -                                |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                     | -                                |
| 合计          | 2,240.00                              | -                                |

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2018年7月20日(基金合同生效日)至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|------------|---------------------------------------|----------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -604,241.72                           | -                                |
| ——股票投资     | -684,019.82                           | -                                |
| ——债券投资     | 79,778.10                             | -                                |
| ——资产支持证券投资 | -                                     | -                                |
| ——贵金属投资    | -                                     | -                                |
| ——其他       | -                                     | -                                |
| 2. 衍生工具    | -248,480.00                           | -                                |
| ——权证投资     | -                                     | -                                |
| 期货投资       | -248,480.00                           | -                                |
| 3. 其他      | -                                     | -                                |
| 合计         | -852,721.72                           | -                                |

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2018年7月20日(基金合同生效日)至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|---------|---------------------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 640,991.76                            | -                                |
| 合计      | 640,991.76                            | -                                |

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018年7月20日(基金合同生效日)至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|-----------|---------------------------------------|----------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 21,134.05                             | -                                |
| 银行间市场交易费用 | 5,100.00                              | -                                |
| 合计        | 26,234.05                             | -                                |

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2018年7月20日(基金合同生效日)至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|----------|---------------------------------------|----------------------------------|
| 审计费用     | 60,000.00                             | -                                |
| 信息披露费    | 66,000.00                             | -                                |
| 银行汇划费用   | 5,969.59                              | -                                |
| 银行间账户维护费 | 12,100.00                             | -                                |
| 合计       | 144,069.59                            | -                                |

**7.4.7.21 分部报告**

无。

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本报告报出日，本基金无需说明的资产负债表日后事项。

**7.4.9 关联方关系**

| 关联方名称                    | 与本基金的关系             |
|--------------------------|---------------------|
| 渤海汇金证券资产管理有限公司（“渤海汇金资管”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）     | 基金托管人、基金销售机构        |
| 渤海证券股份有限公司（“渤海证券”）       | 基金管理人的独资股东、基金销售机构   |



注：1、本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年7月20日(基金合同生效日)至<br>2018年12月31日 |                      | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |                      |
|-------|---|----------------------|----------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                                      | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 渤海证券  | 15,187,609.93                             | 100.00%              | -                                | -                    |

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年7月20日(基金合同生效日)至<br>2018年12月31日 |                      | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |                      |
|-------|---|----------------------|----------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                                      | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例 |
| 渤海证券  | 11,349,663.20                             | 100.00%              | -                                | -                    |

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年7月20日(基金合同生效日)至<br>2018年12月31日 |                            | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |                            |
|-------|---|----------------------------|----------------------------------|----------------------------|
|       | 回购成交金额                                    | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 | 回购成交金额                           | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的比<br>例 |
| 渤海证券  | 581,710,000.00                            | 100.00%                    | -                                | -                          |

**7.4.10.1.4 权证交易**

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年7月20日(基金合同生效日)至2018年12月31日 |                |           |                  |
|-------|---------------------------------------|----------------|-----------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                              | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 渤海证券  | 16,323.19                             | 100.00%        | 15,792.16 | 100.00%          |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日      |                |           |                  |
|       | 当期<br>佣金                              | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2018年7月20日(基金合同生效日)至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------------|----------------------------------|
|                 | 当期发生的基金应支付的管理费                        | 679,436.55                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 352,377.92                            | -                                |

注：支付基金管理人渤海汇金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2018年7月20日(基金合同生效日)至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|----|---------------------------------------|----------------------------------|
|    | 当期发生的基金应支付的托管费                        | 113,239.43                       |

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内无销售服务费。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                         | 本期                              | 上年度可比期间               |
|----------------------------|---------------------------------|-----------------------|
|                            | 2018年7月20日(基金合同生效日)至2018年12月31日 | 2017年1月1日至2017年12月31日 |
| 基金合同生效日(2018年7月20日)持有的基金份额 | 339,592.49                      | -                     |
| 期初持有的基金份额                  | -                               | -                     |
| 期间申购/买入总份额                 | -                               | -                     |
| 期间因拆分变动份额                  | -                               | -                     |
| 减：期间赎回/卖出总份额               | -                               | -                     |
| 期末持有的基金份额                  | 339,592.49                      | -                     |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例          | 0.5600%                         | -                     |

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期                              |           | 上年度可比期间               |        |
|-------|---------------------------------|-----------|-----------------------|--------|
|       | 2018年7月20日(基金合同生效日)至2018年12月31日 |           | 2017年1月1日至2017年12月31日 |        |
|       | 期末余额                            | 当期利息收入    | 期末余额                  | 当期利息收入 |
| 工商银行  | 239,748.62                      | 36,959.48 | -                     | -      |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期             | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期            | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
|--------|------|------------------|--------|--------|-----------------|--------|-------|-----------|-----------|----|
| 600030 | 中信证券 | 2018 年 12 月 24 日 | 重大资产重组 | 16.01  | 2019 年 1 月 10 日 | 17.15  | 3,000 | 51,410.00 | 48,030.00 | -  |

注：本集合计划截至 2018 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大资产重组可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，理论上其风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立以董事会为风险管理的最高决策机构，以经营层负责风险管理主体责任，以首席风险官负责风险管理工作具体推动落实，以风险管

理委员会为风险管理工作指导机构，由专职的风险控制部门为风险管理的督导执行部门，由管理、支持与保障部门及业务部门、各分支机构为风险管理的具体落实部门的多层级的全面风险管理体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 19,511,000.00           | -                        |
| 合计     | 19,511,000.00           | -                        |

注：未评级债券为未有第三方评级的银行间同业存单。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | -                       | -                        |
| AAA 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 11,426,951.30           | -                        |
| 合计     | 11,426,951.30           | -                        |

注：未评级债券为国债及政策性金融债等免评级债券。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

**7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。

**7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

注：无。

**7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

本基金为混合型基金，于 2018 年 12 月 31 日，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或

者银行间同业市场交易，评估结果显示本基金组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2018年<br>12月31<br>日 | 1个月以内         | 1-3个月        | 3个月-1年       | 1-5年         | 5年以上   | 不计息           | 合计            |
|----------------------------|---------------|--------------|--------------|--------------|--------|---------------|---------------|
| 资产                         |               |              |              |              |        |               |               |
| 银行存款                       | 239,748.62    | -            | -            | -            | -      | -             | 239,748.62    |
| 结算备付金                      | 1,568,760.18  | -            | -            | -            | -      | -             | 1,568,760.18  |
| 存出保证金                      | 2,451.80      | -            | -            | -            | -      | 775,219.20    | 777,671.00    |
| 交易性金融资产                    | 9,668,000.00  | 9,843,000.00 | 3,751,100.40 | 7,674,935.40 | 915.50 | 8,715,491.00  | 39,653,442.30 |
| 买入返售金融资产                   | 17,400,000.00 | -            | -            | -            | -      | -             | 17,400,000.00 |
| 应收证券清算款                    | -             | -            | -            | -            | -      | 254,979.48    | 254,979.48    |
| 应收利息                       | -             | -            | -            | -            | -      | 617,965.26    | 617,965.26    |
| 其他资产                       | -             | -            | -            | -            | -      | -248,480.00   | -248,480.00   |
| 资产总计                       | 28,878,960.60 | 9,843,000.00 | 3,751,100.40 | 7,674,935.40 | 915.50 | 10,115,174.94 | 60,264,086.84 |
| 负债                         |               |              |              |              |        |               |               |
| 应付赎回款                      | -             | -            | -            | -            | -      | 53,651.70     | 53,651.70     |

|                             |               |              |              |              |        |              |               |
|-----------------------------|---------------|--------------|--------------|--------------|--------|--------------|---------------|
| 应付管理人报酬                     | -             | -            | -            | -            | -      | 77,715.19    | 77,715.19     |
| 应付托管费                       | -             | -            | -            | -            | -      | 12,952.53    | 12,952.53     |
| 应付交易费用                      | -             | -            | -            | -            | -      | 16,842.16    | 16,842.16     |
| 其他负债                        | -             | -            | -            | -            | -      | 135,134.79   | 135,134.79    |
| 负债总计                        | -             | -            | -            | -            | -      | 296,296.37   | 296,296.37    |
| 利率敏感度缺口                     | 28,878,960.60 | 9,843,000.00 | 3,751,100.40 | 7,674,935.40 | 915.50 | 9,818,878.57 | 59,967,790.47 |
| 上年度末<br>2017年<br>12月31<br>日 | 1个月以内         | 1-3个月        | 3个月-1年       | 1-5年         | 5年以上   | 不计息          | 合计            |
| 资产                          |               |              |              |              |        |              |               |
| 负债                          |               |              |              |              |        |              |               |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                   |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |                    | 本期末（2018年12月31日）            | 上年度末（2017年12月31日） |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | -2.84                       | -                 |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 2.90                        |                   |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，



结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |                       |
|---------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|               | 公允价值                    | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 8,715,491.00            | 14.53                    | -                        | -                     |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                       | -                        | -                        | -                     |
| 交易性金融资产-债券投资  | 30,937,951.30           | 51.59                    | -                        | -                     |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | -                       | -                        | -                        | -                     |
| 衍生金融资产-权证投资   | -                       | -                        | -                        | -                     |
| 其他            | -                       | -                        | -                        | -                     |
| 合计            | 39,653,442.30           | 66.12                    | -                        | -                     |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 分析 | 相关风险变量的变动   | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|----|-------------|-----------------------------|------------------------|
|    |             | 本期末（2018 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2017 年 12 月 31 日） |
|    | 业绩比较基准下降 5% | 27.21                       | -                      |
|    | 业绩比较基准下降 5% | -27.21                      | -                      |

注：单位：万元

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最

低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 20,094,412.30 元，第二层次的余额为人民币 19,559,030.00 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 8,715,491.00  | 14.46         |
|    | 其中：股票             | 8,715,491.00  | 14.46         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 30,937,951.30 | 51.34         |
|    | 其中：债券             | 30,937,951.30 | 51.34         |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | 17,400,000.00 | 28.87         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,808,508.80  | 3.00          |
| 8  | 其他各项资产            | 1,402,135.74  | 2.33          |
| 9  | 合计                | 60,264,086.84 | 100.00        |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 141,269.00   | 0.24          |
| B  | 采矿业              | 93,718.00    | 0.16          |
| C  | 制造业              | 5,162,906.00 | 8.61          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 358,676.00   | 0.60          |
| E  | 建筑业              | 217,620.00   | 0.36          |
| F  | 批发和零售业           | 318,908.00   | 0.53          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 247,379.00   | 0.41          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,216,062.00 | 2.03          |
| J  | 金融业              | 315,810.00   | 0.53          |
| K  | 房地产业             | 236,831.00   | 0.39          |

|   |               |              |       |
|---|---------------|--------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业      | 50,416.00    | 0.08  |
| M | 科学研究和技术服务业    | -            | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 173,816.00   | 0.29  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -            | -     |
| P | 教育            | -            | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 120,744.00   | 0.20  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 61,336.00    | 0.10  |
| S | 综合            | -            | -     |
|   | 合计            | 8,715,491.00 | 14.53 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1  | 601789 | 宁波建工 | 70,200 | 217,620.00 | 0.36         |
| 2  | 002104 | 恒宝股份 | 36,100 | 211,546.00 | 0.35         |
| 3  | 002406 | 远东传动 | 38,000 | 201,020.00 | 0.34         |
| 4  | 600012 | 皖通高速 | 32,100 | 193,563.00 | 0.32         |
| 5  | 603258 | 电魂网络 | 10,200 | 173,502.00 | 0.29         |
| 6  | 600616 | 金枫酒业 | 35,100 | 167,076.00 | 0.28         |
| 7  | 002091 | 江苏国泰 | 27,900 | 156,240.00 | 0.26         |
| 8  | 000791 | 甘肃电投 | 30,400 | 153,824.00 | 0.26         |
| 9  | 600295 | 鄂尔多斯 | 20,100 | 150,750.00 | 0.25         |
| 10 | 603399 | 吉翔股份 | 15,100 | 148,282.00 | 0.25         |
| 11 | 000601 | 韶能股份 | 39,700 | 147,684.00 | 0.25         |
| 12 | 601929 | 吉视传媒 | 70,100 | 143,705.00 | 0.24         |
| 13 | 300212 | 易华录  | 6,800  | 140,896.00 | 0.23         |
| 14 | 600677 | 航天通信 | 14,600 | 138,262.00 | 0.23         |
| 15 | 600486 | 扬农化工 | 3,600  | 135,576.00 | 0.23         |
| 16 | 300511 | 雪榕生物 | 22,700 | 135,519.00 | 0.23         |
| 17 | 300468 | 四方精创 | 11,200 | 134,960.00 | 0.23         |
| 18 | 000546 | 金圆股份 | 15,300 | 132,498.00 | 0.22         |
| 19 | 002232 | 启明信息 | 19,500 | 132,405.00 | 0.22         |
| 20 | 002387 | 黑牛食品 | 17,300 | 131,826.00 | 0.22         |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 21 | 600973 | 宝胜股份 | 36,100 | 130,682.00 | 0.22 |
| 22 | 002501 | 利源精制 | 45,700 | 129,331.00 | 0.22 |
| 23 | 300285 | 国瓷材料 | 7,700  | 128,359.00 | 0.21 |
| 24 | 002322 | 理工环科 | 14,000 | 127,120.00 | 0.21 |
| 25 | 600261 | 阳光照明 | 36,900 | 125,829.00 | 0.21 |
| 26 | 000910 | 大亚圣象 | 12,200 | 125,782.00 | 0.21 |
| 27 | 300059 | 东方财富 | 10,300 | 124,630.00 | 0.21 |
| 28 | 600320 | 振华重工 | 39,200 | 124,264.00 | 0.21 |
| 29 | 601318 | 中国平安 | 2,200  | 123,420.00 | 0.21 |
| 30 | 300625 | 三雄极光 | 8,700  | 122,409.00 | 0.20 |
| 31 | 601369 | 陕鼓动力 | 20,200 | 122,210.00 | 0.20 |
| 32 | 300307 | 慈星股份 | 25,200 | 120,456.00 | 0.20 |
| 33 | 600075 | 新疆天业 | 26,600 | 120,232.00 | 0.20 |
| 34 | 603898 | 好莱客  | 7,800  | 119,574.00 | 0.20 |
| 35 | 600519 | 贵州茅台 | 200    | 118,002.00 | 0.20 |
| 36 | 601588 | 北辰实业 | 43,000 | 116,530.00 | 0.19 |
| 37 | 300303 | 聚飞光电 | 47,200 | 114,696.00 | 0.19 |
| 38 | 000782 | 美达股份 | 26,800 | 114,436.00 | 0.19 |
| 39 | 002139 | 拓邦股份 | 28,900 | 113,288.00 | 0.19 |
| 40 | 600322 | 天房发展 | 34,100 | 110,825.00 | 0.18 |
| 41 | 600036 | 招商银行 | 3,800  | 95,760.00  | 0.16 |
| 42 | 603899 | 晨光文具 | 2,400  | 72,600.00  | 0.12 |
| 43 | 002311 | 海大集团 | 3,000  | 69,510.00  | 0.12 |
| 44 | 000651 | 格力电器 | 1,800  | 64,242.00  | 0.11 |
| 45 | 600498 | 烽火通信 | 2,200  | 62,634.00  | 0.10 |
| 46 | 002099 | 海翔药业 | 13,800 | 62,376.00  | 0.10 |
| 47 | 600588 | 用友网络 | 2,800  | 59,640.00  | 0.10 |
| 48 | 601100 | 恒立液压 | 3,000  | 59,430.00  | 0.10 |
| 49 | 002626 | 金达威  | 4,800  | 57,696.00  | 0.10 |
| 50 | 600900 | 长江电力 | 3,600  | 57,168.00  | 0.10 |
| 51 | 600763 | 通策医疗 | 1,200  | 56,964.00  | 0.09 |
| 52 | 002475 | 立讯精密 | 4,000  | 56,240.00  | 0.09 |
| 53 | 300408 | 三环集团 | 3,300  | 55,836.00  | 0.09 |
| 54 | 600760 | 中航沈飞 | 2,000  | 55,420.00  | 0.09 |
| 55 | 300015 | 爱尔眼科 | 2,100  | 55,230.00  | 0.09 |
| 56 | 600031 | 三一重工 | 6,600  | 55,044.00  | 0.09 |
| 57 | 603288 | 海天味业 | 800    | 55,040.00  | 0.09 |
| 58 | 002493 | 荣盛石化 | 5,400  | 54,486.00  | 0.09 |
| 59 | 002901 | 大博医疗 | 1,800  | 53,262.00  | 0.09 |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 60 | 002032 | 苏泊尔  | 1,000 | 52,500.00 | 0.09 |
| 61 | 300124 | 汇川技术 | 2,600 | 52,364.00 | 0.09 |
| 62 | 600570 | 恒生电子 | 1,000 | 51,980.00 | 0.09 |
| 63 | 002507 | 涪陵榨菜 | 2,400 | 51,840.00 | 0.09 |
| 64 | 600009 | 上海机场 | 1,000 | 50,760.00 | 0.08 |
| 65 | 600346 | 恒力股份 | 3,800 | 50,350.00 | 0.08 |
| 66 | 600887 | 伊利股份 | 2,200 | 50,336.00 | 0.08 |
| 67 | 601088 | 中国神华 | 2,800 | 50,288.00 | 0.08 |
| 68 | 600660 | 福耀玻璃 | 2,200 | 50,116.00 | 0.08 |
| 69 | 300529 | 健帆生物 | 1,200 | 49,800.00 | 0.08 |
| 70 | 000898 | 鞍钢股份 | 9,600 | 49,248.00 | 0.08 |
| 71 | 601688 | 华泰证券 | 3,000 | 48,600.00 | 0.08 |
| 72 | 601888 | 中国国旅 | 800   | 48,160.00 | 0.08 |
| 73 | 600030 | 中信证券 | 3,000 | 48,030.00 | 0.08 |
| 74 | 600585 | 海螺水泥 | 1,600 | 46,848.00 | 0.08 |
| 75 | 600426 | 华鲁恒升 | 3,800 | 45,866.00 | 0.08 |
| 76 | 300136 | 信维通信 | 2,100 | 45,381.00 | 0.08 |
| 77 | 600028 | 中国石化 | 8,600 | 43,430.00 | 0.07 |
| 78 | 300253 | 卫宁健康 | 3,300 | 41,118.00 | 0.07 |
| 79 | 300024 | 机器人  | 3,100 | 40,982.00 | 0.07 |
| 80 | 600309 | 万华化学 | 1,400 | 39,186.00 | 0.07 |
| 81 | 000661 | 长春高新 | 200   | 35,000.00 | 0.06 |
| 82 | 300450 | 先导智能 | 1,200 | 34,728.00 | 0.06 |
| 83 | 300017 | 网宿科技 | 4,200 | 32,886.00 | 0.05 |
| 84 | 300070 | 碧水源  | 4,200 | 32,760.00 | 0.05 |
| 85 | 300146 | 汤臣倍健 | 1,900 | 32,281.00 | 0.05 |
| 86 | 600276 | 恒瑞医药 | 600   | 31,650.00 | 0.05 |
| 87 | 300122 | 智飞生物 | 800   | 31,008.00 | 0.05 |
| 88 | 300383 | 光环新网 | 2,400 | 30,408.00 | 0.05 |
| 89 | 300413 | 快乐购  | 800   | 29,608.00 | 0.05 |
| 90 | 300003 | 乐普医疗 | 1,400 | 29,134.00 | 0.05 |
| 91 | 300072 | 三聚环保 | 2,900 | 28,536.00 | 0.05 |
| 92 | 300357 | 我武生物 | 700   | 25,893.00 | 0.04 |
| 93 | 300315 | 掌趣科技 | 6,800 | 24,004.00 | 0.04 |
| 94 | 002007 | 华兰生物 | 700   | 22,960.00 | 0.04 |
| 95 | 300088 | 长信科技 | 5,000 | 20,750.00 | 0.03 |
| 96 | 000858 | 五粮液  | 400   | 20,352.00 | 0.03 |
| 97 | 603986 | 兆易创新 | 300   | 18,696.00 | 0.03 |
| 98 | 300226 | 上海钢联 | 400   | 18,212.00 | 0.03 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 99  | 600436 | 片仔癀  | 200   | 17,330.00 | 0.03 |
| 100 | 300251 | 光线传媒 | 2,200 | 16,720.00 | 0.03 |
| 101 | 300073 | 当升科技 | 600   | 16,614.00 | 0.03 |
| 102 | 300316 | 晶盛机电 | 1,600 | 16,032.00 | 0.03 |
| 103 | 300014 | 亿纬锂能 | 1,000 | 15,720.00 | 0.03 |
| 104 | 300033 | 同花顺  | 400   | 15,280.00 | 0.03 |
| 105 | 002371 | 北方华创 | 400   | 15,104.00 | 0.03 |
| 106 | 300027 | 华谊兄弟 | 3,200 | 15,008.00 | 0.03 |
| 107 | 300618 | 寒锐钴业 | 200   | 14,816.00 | 0.02 |
| 108 | 603019 | 中科曙光 | 400   | 14,352.00 | 0.02 |
| 109 | 300170 | 汉得信息 | 1,400 | 13,692.00 | 0.02 |
| 110 | 002179 | 中航光电 | 400   | 13,472.00 | 0.02 |
| 111 | 300418 | 昆仑万维 | 1,000 | 12,860.00 | 0.02 |
| 112 | 600771 | 广誉远  | 400   | 11,548.00 | 0.02 |
| 113 | 300098 | 高新兴  | 1,600 | 10,816.00 | 0.02 |
| 114 | 300009 | 安科生物 | 800   | 10,688.00 | 0.02 |
| 115 | 002415 | 海康威视 | 400   | 10,304.00 | 0.02 |
| 116 | 300113 | 顺网科技 | 800   | 10,168.00 | 0.02 |
| 117 | 300115 | 长盈精密 | 1,200 | 9,828.00  | 0.02 |
| 118 | 601155 | 新城控股 | 400   | 9,476.00  | 0.02 |
| 119 | 603883 | 老百姓  | 200   | 9,442.00  | 0.02 |
| 120 | 300222 | 科大智能 | 600   | 9,300.00  | 0.02 |
| 121 | 300433 | 蓝思科技 | 1,400 | 9,114.00  | 0.02 |
| 122 | 600885 | 宏发股份 | 400   | 9,024.00  | 0.02 |
| 123 | 300496 | 中科创达 | 400   | 8,840.00  | 0.01 |
| 124 | 300377 | 赢时胜  | 800   | 8,832.00  | 0.01 |
| 125 | 300355 | 蒙草生态 | 2,200 | 8,558.00  | 0.01 |
| 126 | 300347 | 泰格医药 | 200   | 8,550.00  | 0.01 |
| 127 | 300287 | 飞利信  | 2,200 | 8,316.00  | 0.01 |
| 128 | 300666 | 江丰电子 | 200   | 8,264.00  | 0.01 |
| 129 | 300053 | 欧比特  | 1,000 | 8,160.00  | 0.01 |
| 130 | 300274 | 阳光电源 | 900   | 8,028.00  | 0.01 |
| 131 | 300134 | 大富科技 | 800   | 7,520.00  | 0.01 |
| 132 | 300038 | 梅泰诺  | 800   | 7,464.00  | 0.01 |
| 133 | 600741 | 华域汽车 | 400   | 7,360.00  | 0.01 |
| 134 | 300699 | 光威复材 | 200   | 7,160.00  | 0.01 |
| 135 | 601012 | 隆基股份 | 400   | 6,976.00  | 0.01 |
| 136 | 000977 | 浪潮信息 | 400   | 6,368.00  | 0.01 |
| 137 | 002714 | 牧原股份 | 200   | 5,750.00  | 0.01 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 138 | 000786 | 北新建材 | 400 | 5,504.00 | 0.01 |
| 139 | 300085 | 银之杰  | 600 | 4,776.00 | 0.01 |
| 140 | 002236 | 大华股份 | 400 | 4,584.00 | 0.01 |
| 141 | 002640 | 跨境通  | 400 | 4,320.00 | 0.01 |
| 142 | 600845 | 宝信软件 | 200 | 4,170.00 | 0.01 |
| 143 | 002202 | 金凤科技 | 400 | 3,996.00 | 0.01 |
| 144 | 002024 | 苏宁易购 | 400 | 3,940.00 | 0.01 |
| 145 | 002727 | 一心堂  | 200 | 3,556.00 | 0.01 |
| 146 | 601933 | 永辉超市 | 400 | 3,148.00 | 0.01 |
| 147 | 601111 | 中国国航 | 400 | 3,056.00 | 0.01 |
| 148 | 002013 | 中航机电 | 400 | 2,604.00 | 0.00 |
| 149 | 300431 | 暴风集团 | 300 | 2,502.00 | 0.00 |
| 150 | 002127 | 南极电商 | 300 | 2,256.00 | 0.00 |
| 151 | 300296 | 利亚德  | 100 | 769.00   | 0.00 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额   | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|------------|-----------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 337,716.00 | 0.56            |
| 2  | 601789 | 宁波建工 | 238,617.00 | 0.40            |
| 3  | 002406 | 远东传动 | 218,350.00 | 0.36            |
| 4  | 002104 | 恒宝股份 | 211,442.00 | 0.35            |
| 5  | 600012 | 皖通高速 | 188,413.00 | 0.31            |
| 6  | 600616 | 金枫酒业 | 184,653.00 | 0.31            |
| 7  | 600295 | 鄂尔多斯 | 162,875.00 | 0.27            |
| 8  | 603258 | 电魂网络 | 162,591.00 | 0.27            |
| 9  | 601929 | 吉视传媒 | 159,621.00 | 0.27            |
| 10 | 002091 | 江苏国泰 | 158,621.00 | 0.26            |
| 11 | 000601 | 韶能股份 | 157,815.00 | 0.26            |
| 12 | 000791 | 甘肃电投 | 156,354.00 | 0.26            |
| 13 | 603399 | 吉翔股份 | 154,903.00 | 0.26            |
| 14 | 002501 | 利源精制 | 153,683.00 | 0.26            |
| 15 | 300212 | 易华录  | 147,816.00 | 0.25            |



|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 16 | 300468 | 四方精创 | 147,504.00 | 0.25 |
| 17 | 002387 | 黑牛食品 | 147,243.00 | 0.25 |
| 18 | 300511 | 雪榕生物 | 147,084.00 | 0.25 |
| 19 | 600486 | 扬农化工 | 146,118.00 | 0.24 |
| 20 | 601318 | 中国平安 | 145,639.00 | 0.24 |

注：本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额   | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|----------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 159,693.00 | 0.27           |
| 2  | 002262 | 恩华药业 | 112,018.00 | 0.19           |
| 3  | 002178 | 延华智能 | 83,808.00  | 0.14           |
| 4  | 300168 | 万达信息 | 80,766.00  | 0.13           |
| 5  | 300353 | 东土科技 | 72,428.00  | 0.12           |
| 6  | 600119 | 长江投资 | 71,552.00  | 0.12           |
| 7  | 300507 | 苏奥传感 | 69,996.00  | 0.12           |
| 8  | 002481 | 双塔食品 | 63,242.00  | 0.11           |
| 9  | 002099 | 海翔药业 | 62,411.00  | 0.10           |
| 10 | 002425 | 凯撒文化 | 62,118.00  | 0.10           |
| 11 | 600758 | 红阳能源 | 60,352.00  | 0.10           |
| 12 | 600763 | 通策医疗 | 58,448.00  | 0.10           |
| 13 | 002626 | 金达威  | 58,080.00  | 0.10           |
| 14 | 300015 | 爱尔眼科 | 57,654.00  | 0.10           |
| 15 | 300336 | 新文化  | 57,462.00  | 0.10           |
| 16 | 002086 | 东方海洋 | 56,679.00  | 0.09           |
| 17 | 000155 | 川化股份 | 56,560.00  | 0.09           |
| 18 | 603881 | 数据港  | 56,400.00  | 0.09           |
| 19 | 300328 | 宜安科技 | 55,755.00  | 0.09           |
| 20 | 603817 | 海峡环保 | 55,228.86  | 0.09           |

注：本项的“累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

**8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

单位：人民币元

|              |               |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 12,364,728.07 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,822,881.86  |

注：本项的“买入股票成本(成交)总额”及“卖出股票收入(成交)总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

**8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 7,853,770.90  | 13.10        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 3,573,180.40  | 5.96         |
|    | 其中：政策性金融债 | 3,573,180.40  | 5.96         |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | 19,511,000.00 | 32.54        |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 30,937,951.30 | 51.59        |

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量（张）   | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 111806216 | 18 交通银行 CD216 | 100,000 | 9,843,000.00 | 16.41        |
| 2  | 111894921 | 18 南京银行 CD057 | 100,000 | 9,668,000.00 | 16.12        |
| 3  | 010303    | 03 国债(3)      | 40,470  | 4,080,185.40 | 6.80         |
| 4  | 010107    | 21 国债(7)      | 25,000  | 2,573,750.00 | 4.29         |
| 5  | 018005    | 国开 1701       | 25,410  | 2,552,180.40 | 4.26         |

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

注：本基金报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

| 代码                | 名称               | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元)      | 公允价值变动（元）   | 风险说明        |
|-------------------|------------------|----------|--------------|-------------|-------------|
| IC1901            | 中证 500 股指期货 1901 | 2        | 1,652,400.00 | -41,120.00  | -           |
| IC1903            | 中证 500 股指期货 1903 | 2        | 1,635,600.00 | -136,200.00 | -           |
| IF1901            | 沪深 300 股指期货 1901 | 2        | 1,802,160.00 | -71,160.00  | -           |
| 公允价值变动总额合计（元）     |                  |          |              |             | -248,480.00 |
| 股指期货投资本期收益（元）     |                  |          |              |             | -81,879.03  |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |                  |          |              |             | -248,480.00 |

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，选择流动性较强、交易活跃的期货合约进行空头或多头套期保值，以管理投资组合的系统性风险，提高资金使用效率。

基金管理人针对股指期货交易制定严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运行，并明确相关岗位职责。此外，基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组，并授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，

以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期末未持有。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

无。

### 8.12.2 本基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

无。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 777,671.00   |
| 2  | 应收证券清算款 | 6,499.48     |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 617,965.26   |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,402,135.74 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### **8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构           |            |                  |            |
|--------------|---------------|-----------------|------------|------------------|------------|
|              |               | 机构投资者           |            | 个人投资者            |            |
|              |               | 持有份额            | 占总份<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 623          | 97, 129. 14   | 1, 838, 511. 78 | 3. 04%     | 58, 672, 941. 88 | 96. 96%    |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份）       | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 1, 117, 976. 34 | 1. 8475% |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 50~100            |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 10~50             |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2018年7月20日）基金份额总额          | 234,129,606.83 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | -              |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 152,321.45     |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 173,770,474.62 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 60,511,453.66  |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金基金管理人重大人事变动：

本基金管理人于 2018 年 7 月 25 日发布公告，自 2018 年 7 月 23 日起，渤海汇金证券资产管理有限公司的董事会秘书由李唤工先生变更为周里勇先生。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，管理人与前员工发生劳动争议民事诉讼，对基金份额持有人利益无任何不利影响。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为其审计机构。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 60,000.00 元。该审计机构为本基金提供审计服务的期间为基金成立日(2018 年 7 月 20 日)起至本报告期末，不满一年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人、托管人及高级管理人员受到稽查或者处罚情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元



| 券商名称 | 交易单元<br>数量 | 股票交易          |                      | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|------|------------|---------------|----------------------|-----------|----------------|----|
|      |            | 成交金额          | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 | 佣金        | 占当期佣金<br>总量的比例 |    |
| 渤海证券 | 2          | 15,187,609.93 | 100.00%              | 16,323.19 | 100.00%        | -  |

注：1、本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计。

#### 2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准：券商经营行为规范；具有较强的研究服务能力，包括研究及投资建议质量、报告的及时性和服务质量；交易佣金收费合理。

(2) 选择程序：基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、截至本报告期末，本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格；本公司已在深圳交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

4、本基金本报告期内无新增券商交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易          |                      | 债券回购交易         |                            | 权证交易 |                      |
|------|---------------|----------------------|----------------|----------------------------|------|----------------------|
|      | 成交金额          | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例 | 成交金额           | 占当期债<br>券回购<br>成交总额<br>的比例 | 成交金额 | 占当期权证<br>成交总额的<br>比例 |
| 渤海证券 | 11,349,663.20 | 100.00%              | 581,710,000.00 | 100.00%                    | -    | -                    |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项           | 法定披露方式 | 法定披露日期     |
|----|----------------|--------|------------|
| 1  | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合 | 公司网站   | 2018年5月16日 |

|    |  |           |            |
|----|--|-----------|------------|
|    | 型证券投资基金基金合同                                  |           |            |
| 2  | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要                  | 证券时报、公司网站 | 2018年5月16日 |
| 3  | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议                    | 公司网站      | 2018年5月16日 |
| 4  | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书                   | 证券时报、公司网站 | 2018年5月16日 |
| 5  | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告                | 证券时报、公司网站 | 2018年5月16日 |
| 6  | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于参加上海基煜基金销售有限公司优惠活动的公告        | 公司网站      | 2018年5月17日 |
| 7  | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于参加天天基金网、好买网费率优惠活动的公告         | 公司网站      | 2018年5月17日 |
| 8  | 关于旗下渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金开展直销柜台费率优惠活动的公告     | 证券时报、公司网站 | 2018年5月21日 |
| 9  | 关于渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金新增部分渠道为代销机构的公告        | 证券时报、公司网站 | 2018年5月25日 |
| 10 | 关于渤海汇金证券资产管理有限公司增加天津国美基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018年5月25日 |
| 11 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于参加天津国美基金销售有限公司费率优惠活动的公告      | 证券时报、公司网站 | 2018年5月25日 |

|    |   |           |            |
|----|---|-----------|------------|
| 12 | 关于渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金新增部分渠道为代销机构的公告【东海证券】 | 证券时报、公司网站 | 2018年6月5日  |
| 13 | 关于渤海汇金证券资产管理有限公司增加东海证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告  | 证券时报、公司网站 | 2018年6月5日  |
| 14 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于参加东海证券股份有限公司费率优惠活动的公告       | 证券时报、公司网站 | 2018年6月5日  |
| 15 | 关于渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金延长募集期的公告             | 证券时报、公司网站 | 2018年6月15日 |
| 16 | 关于渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金延长募集期的公告             | 证券时报、公司网站 | 2018年7月13日 |
| 17 | 关于渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集的公告            | 证券时报、公司网站 | 2018年7月17日 |
| 18 | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告               | 证券时报、公司网站 | 2018年7月21日 |
| 19 | 2018年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员（董事会秘书）变更公告       | 证券时报、公司网站 | 2018年7月25日 |
| 20 | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告         | 证券时报、公司网站 | 2018年8月16日 |
| 21 | 关于旗下渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金参加工                | 证券时报、公司网站 | 2018年8月17日 |

|    |   |           |                  |
|----|---|-----------|------------------|
|    | 商银行基金申购费率优惠活动的公告                              |           |                  |
| 22 | 关于旗下部分基金增加北京恒宇天泽基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告   | 证券时报、公司网站 | 2018 年 8 月 17 日  |
| 23 | 关于旗下部分基金增加民商基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告       | 证券时报、公司网站 | 2018 年 8 月 24 日  |
| 24 | 关于旗下部分基金增加中信建投证券股份有限公司为代销机构的公告                | 证券时报、公司网站 | 2018 年 8 月 31 日  |
| 25 | 关于旗下部分基金增加北京唐鼎耀华基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告   | 证券时报、公司网站 | 2018 年 8 月 31 日  |
| 26 | 关于旗下部分基金增加信达证券股份有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告       | 证券时报、公司网站 | 2018 年 9 月 14 日  |
| 27 | 关于旗下部分基金增加上海联泰资产管理有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告     | 证券时报、公司网站 | 2018 年 9 月 14 日  |
| 28 | 关于旗下部分基金增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 10 月 23 日 |
| 29 | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告          | 证券时报、公司网站 | 2018 年 10 月 25 日 |

|    |   |           |                  |
|----|---|-----------|------------------|
| 30 | 关于旗下部分基金增加嘉实财富管理有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告                 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 10 月 26 日 |
| 31 | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金开放定期定额投资业务公告                       | 证券时报、公司网站 | 2018 年 11 月 1 日  |
| 32 | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通基金定投业务并参加定投业务优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 11 月 2 日  |
| 33 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于为旗下部分基金开通网上直销系统并开展费率优惠活动的公告             | 证券时报、公司网站 | 2018 年 11 月 7 日  |
| 34 | 关于旗下部分基金增加深圳前海财厚基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告             | 证券时报、公司网站 | 2018 年 12 月 5 日  |
| 35 | 关于旗下部分基金增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告           | 证券时报、公司网站 | 2018 年 12 月 20 日 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |               |      |               | 报告期末持有基金情况 |       |
|--|----------------|-------------------------|---------------|------|---------------|------------|-------|
|  | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额          | 持有份额       | 份额占比  |
| 机构   | 1              | 20180720-20180820       | 49,000,932.78 | 0.00 | 49,000,932.78 | 0.00       | 0.00% |
| 个人   | -              | -                       | -             | -    | -             | -          | -     |
| -  | -              | -                       | -             | -    | -             | -          | -     |
| 产品特有风险   |                |                         |               |      |               |            |       |
| <p>报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 单一大额投资者大额赎回对基金净值波动的影响。</li> <li>2. 单一大额投资者大额赎回时为应对赎回证券变现产生的冲击成本的风险。</li> <li>3. 单一大额投资者退出后，可能出现迷你基金的情形，可能影响投资目标的实现。</li> <li>4. 单一大额投资者可能对持有人大会施加重大影响。</li> </ol> |                |                         |               |      |               |            |       |

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；

2、《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

4、《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

6、渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上的各项公告。

### 13.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

### 13.3 查阅方式

上述文件可在渤海汇金证券资产管理有限公司网站上查阅，或者在营业时间内到渤海汇金证券资产管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司。

客服电话：400-651-5988/400-651-1717

管理人网站：<https://www.bhhjamc.com>

渤海汇金证券资产管理有限公司

2019年3月28日